

# LM・オーストラリア債券ファンド (年2回決算型)

## 運用報告書（全体版）

第15期 決算日 2020年12月10日

### － 受益者のみなさまへ －

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。  
さて、「LM・オーストラリア債券ファンド(年2回決算型)」は、2020年12月10日に第15期の決算を行いましたので、期中の運用状況と収益分配金をご報告申し上げます。  
今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

◇当ファンドの仕組みは、次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／債券	
信託期間	無期限	
運用方針	主として豪ドル建の公社債に投資を行い、中長期的な信託財産の成長を目指します。	
主要運用対象	当ファンド	「LM・豪ドル債券マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。
	LM・豪ドル債券マザーファンド	主として豪ドル建の国債、州政府債、国際機関債、社債、モーゲージ証券及び資産担保証券等を主要投資対象とします。
組入制限	外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。	
分配方針	決算日(原則として毎年6月10日及び12月10日。休業日の場合は翌営業日)に、基準価額水準等を勘案して収益の分配を行います。	

当報告書に関するお問い合わせ先：

レグ・メイソン・アセット・マネジメント株式会社

お問い合わせ窓口

電話番号：03-5219-5947

## レグ・メイソン・アセット・マネジメント株式会社

〒100-6536 東京都千代田区丸の内一丁目5番1号

レグ・メイソン・アセット・マネジメント株式会社(金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第417号)はフランクリン・リソース・インク傘下の資産運用会社です。

レグ・メイソン・アセット・マネジメント株式会社は、2021年4月1日付でフランクリン・テンプレトン・インベストメンツ株式会社を吸収合併し、商号を「フランクリン・テンプレトン・ジャパン株式会社」に変更する予定です。

<https://www.leggmason.co.jp>

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準 (分配落)	価額		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
		税 分 配 金	騰 落 率			
	円	円	%	%	%	百万円
11期(2018年12月10日)	10,282	0	△0.4	98.0	0.5	1,098
12期(2019年6月10日)	10,193	0	△0.9	97.9	△0.3	1,186
13期(2019年12月10日)	10,196	0	0.0	98.5	△0.4	1,360
14期(2020年6月10日)	10,330	0	1.3	97.4	2.7	1,282
15期(2020年12月10日)	10,884	0	5.4	98.7	0.4	1,018

(注) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「債券組入比率」「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注) 債券先物比率は買建比率－売建比率。

(注) 市場に広く認知されているベンチマーク等で、当ファンドのリスク特性を正確に反映する指標が見当たらないため、現状では、当ファンドの収益率およびリスク特性を特定のベンチマーク等と比較しておりません。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準	価 額		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	債 先 物 比 率
		騰 落 率	騰 落 率			
(期首) 2020年6月10日	円	円	%	%	%	%
6月末	10,330	10,285	△0.4	97.4	98.1	2.7
7月末	10,526	10,526	1.9	97.9	97.9	1.1
8月末	10,796	10,796	4.5	97.9	97.9	0.2
9月末	10,615	10,615	2.8	98.8	98.8	1.3
10月末	10,375	10,375	0.4	99.1	99.1	0.2
11月末	10,839	10,839	4.9	98.8	98.8	1.3
(期末) 2020年12月10日	10,884	10,884	5.4	98.7	98.7	0.9

(注) 騰落率は期首比です。

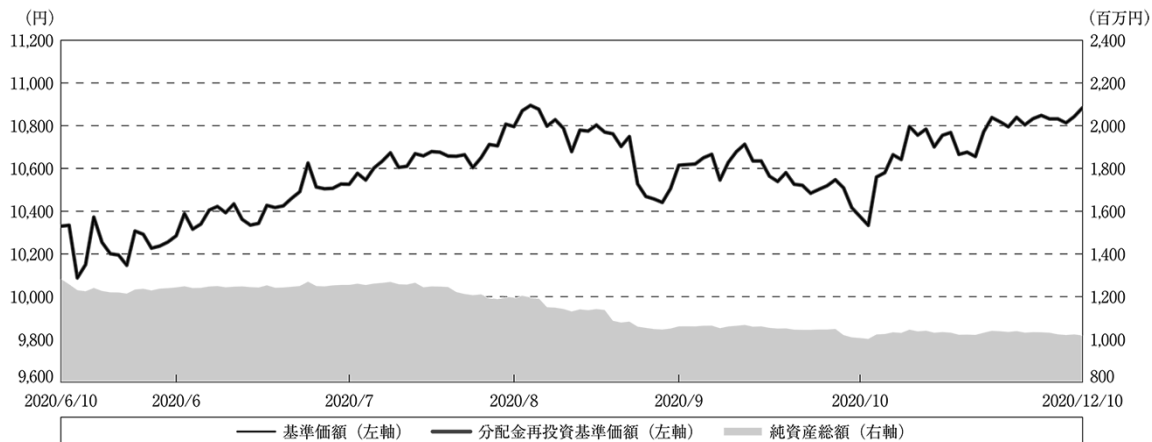
(注) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「債券組入比率」「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注) 債券先物比率は買建比率－売建比率。

## ○運用経過

### 期中の基準価額等の推移

(2020年6月11日～2020年12月10日)



期首：10,330円

期末：10,884円 (既払分配金(税込み)：0円)

騰落率： 5.4% (分配金再投資ベース)

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 分配金再投資基準価額は、期首(2020年6月10日)の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

## ○基準価額の主な変動要因

当期の当ファンドのパフォーマンス(騰落率)は、プラスとなりました。

公社債利金を手堅く確保したことに加え、公社債損益がプラスとなりました。為替損益についても、豪ドル・円相場が豪ドル高・円安となったことから、プラスとなりました。

当期のオーストラリア債券市場は、短中期債を中心に利回りが低下（価格は上昇）しました。

期の前半は、米連邦準備制度理事会（FRB）が長期にわたって緩和的な金融政策を継続する方針を示し、米国内債利回りが低下した影響で、オーストラリアの利回りも低下しました。その後も、ビクトリア州メルボルンの一部地域でロックダウン（都市封鎖）が再実施されるなど、新型コロナウイルスの感染拡大第2波への警戒感が意識される中、利回りは低下基調となりました。

期の半ばは、新型コロナウイルスのワクチン開発への期待などを背景に主要国の株式相場が上昇する中、利回りは上昇（価格は下落）しました。しかしその後は、オーストラリア準備銀行（RBA）が追加緩和策として金融機関向けの資金支援策（ターム・ファンディング・ファシリティ）の拡充を公表したことを受けて、利回りは低下しました。

期の後半は、RBAが政策金利の引き下げと国債買い入れ増額を含む追加の金融緩和策を決定したことなどから、利回りは低下しました。しかしその後は、新型コロナウイルスのワクチンが早期に普及し、経済活動の正常化が進むとの見方が広がったことから、利回りは上昇しました。

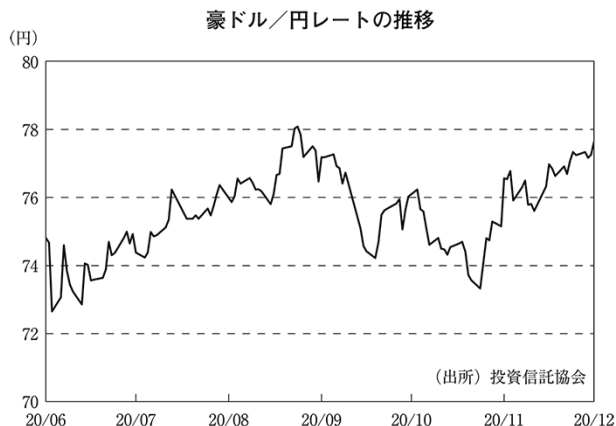
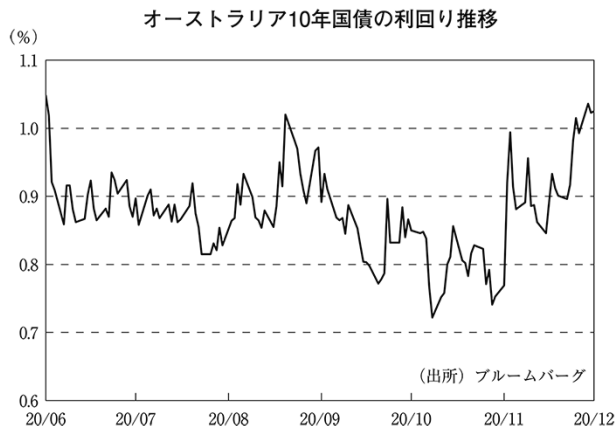
社債セクターについては、株式相場が上昇したことなどから、社債スプレッド（国債に対する上乘せ利回り）は縮小しました。

当期の豪ドル・円相場は、豪ドル高・円安となりました。

期の前半は、新型コロナウイルスの感染拡大第2波に対する懸念が浮上する場面などで、豪ドルは対円で上値の重い展開となりましたが、主要国の株式相場や資源価格が概ね回復基調を辿り、投資家のリスク回避姿勢が和らいだことなどから、豪ドルは対円で上昇しました。

期の半ばは、新型コロナウイルスのワクチン開発への期待感などを背景に主要国の株式相場が上昇する中、リスク回避姿勢の後退が意識されたことから、豪ドル買い・円売りが強まりました。しかしその後は、RBAが追加緩和策として金融機関向けの資金支援策の拡充を公表したことを受けて、豪ドルは対円で下落しました。

期の後半は、RBAによる追加利下げ観測が高まったことや、欧米の新型コロナウイルス感染再拡大を受けてリスク回避姿勢が強まったことなどから、豪ドル売り・円買いが強まりました。しかしその後は、新型コロナウイルスのワクチンの普及による経済活動正常化への期待が高まったことなどから、豪ドル買い・円売りが優勢となりました。



当ファンドは豪ドル建ての国債、州政府債、国際機関債、社債、モーゲージ証券および資産担保証券等を主要投資対象とする「LM・豪ドル債券マザーファンド」受益証券に投資を行い、長期的に安定した利金（インカム）収入が期待できるポートフォリオの運用を行いました。当ファンドは原則としてA-/A3格以上の格付けの公社債へ投資し、信用リスクの抑制を図る等、安定的な運用を目指しております。当期においては、金融債、リート・セクター等を中心とした社債を引き続き厚めとしました。金融債の組み入れにおいては、カバードボンド（債権担保付社債の一種）や、大手金融機関が発行する流動性・信用力が相対的に高い債券が組み入れの中心となっています。また、ポートフォリオ全体の平均格付けは引き続き高位に保ちました。

## 分配金

(2020年6月11日～2020年12月10日)

分配金につきましては、以下の通りとさせていただきます。なお、収益分配に充当しなかった利益につきましては信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づき運用を行います。

### ○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項 目	第15期
	2020年6月11日～ 2020年12月10日
当期分配金	—
(対基準価額比率)	—%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	3,043

(注) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

### ○今後の運用方針

当ファンドは、豪ドル建ての国債、州政府債、国際機関債、社債、モーゲージ証券および資産担保証券等を主要投資対象とするファンドです。引き続き、市場環境に注視しながら、組入債券の信用リスク、金利リスク等に配慮しつつ銘柄を厳選し、運用に注力していく所存です。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2020年6月11日～2020年12月10日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 73	% 0.689	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(35)	(0.331)	委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	(36)	(0.336)	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（ 受 託 会 社 ）	( 2 )	(0.022)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.001	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	( 0 )	(0.001)	売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(c) そ の 他 費 用	3	0.030	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	( 0 )	(0.004)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（ 監 査 費 用 ）	( 1 )	(0.008)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（ 印 刷 等 費 用 ）	( 2 )	(0.017)	印刷等費用は、印刷業者等に支払う法定書類の作成、印刷、交付および届出に係る費用
合 計	76	0.720	
期中の平均基準価額は、10,572円です。			

(注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

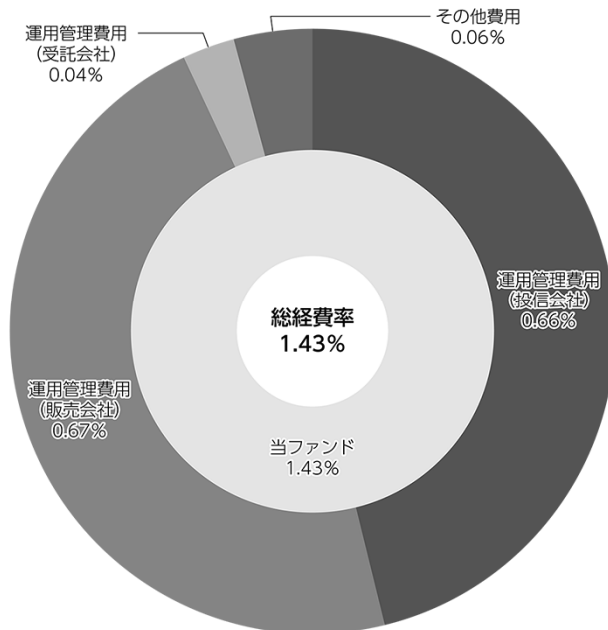
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

## (参考情報)

### ○総経費率

期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.43%です。



(注) 当ファンドの費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 当ファンドの費用は、親投資信託が支払った費用を含みます。

(注) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

## ○売買及び取引の状況

(2020年6月11日～2020年12月10日)

### 親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
LM・豪ドル債券マザーファンド	千口 33,447	千円 82,976	千口 166,820	千円 418,335

(注) 単位未満は切捨て。

## ○利害関係人との取引状況等

(2020年6月11日～2020年12月10日)

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

## ○第二種金融商品取引業を兼業している投資信託委託会社の自己取引状況

(2020年6月11日～2020年12月10日)

該当事項はございません。

## ○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2020年6月11日～2020年12月10日)

該当事項はございません。

## ○組入資産の明細

(2020年12月10日現在)

### 親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
LM・豪ドル債券マザーファンド	千口 530,862	千口 397,490	千円 1,026,359

(注) 単位未満は切捨て。

親投資信託における組入資産の明細につきましては、後述の親投資信託の「運用報告書」をご参照ください。



## ○投資信託財産の構成

(2020年12月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
LM・豪ドル債券マザーファンド	千円 1,026,359	% 99.1
コール・ローン等、その他	9,183	0.9
投資信託財産総額	1,035,542	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

(注) LM・豪ドル債券マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(60,478,791千円)の投資信託財産総額(60,871,174千円)に対する比率は99.4%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、12月10日における邦貨換算レートは1オーストラリアドル=77.62円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年12月10日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,035,542,804
LM・豪ドル債券マザーファンド(評価額)	1,026,359,566
未収入金	9,183,238
(B) 負債	17,344,200
未払解約金	9,183,238
未払信託報酬	7,871,621
その他未払費用	289,341
(C) 純資産総額(A-B)	1,018,198,604
元本	935,477,735
次期繰越損益金	82,720,869
(D) 受益権総口数	935,477,735口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,884円

<注記事項>

元本の状況

期首元本額

1,241,830,960円

期中追加設定元本額

78,999,467円

期中一部解約元本額

385,352,692円

○損益の状況 (2020年6月11日～2020年12月10日)

項 目	当 期
	円
(A) 有価証券売買損益	58,878,426
売買益	70,935,219
売買損	△12,056,793
(B) 信託報酬等	△8,160,962
(C) 当期繰越損益金(A+B)	50,717,464
(D) 前期繰越損益金	8,946,753
(E) 追加信託差損益金	23,056,652
(配当等相当額)	(202,532,261)
(売買損益相当額)	(△179,475,609)
(F) 計(C+D+E)	82,720,869
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	82,720,869
追加信託差損益金	23,056,652
(配当等相当額)	(202,630,561)
(売買損益相当額)	(△179,573,909)
分配準備積立金	82,091,140
繰越損益金	△22,426,923

(注) 損益の状況の中で(A)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注) 損益の状況の中で(B)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注) 損益の状況の中で(E)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するため要する費用として、委託者報酬のうち販売会社へ支払う手数料を除いた額の100分の50相当額を支払っております。

<分配金の計算過程>

決 算 期	当 期
(A) 配当等収益(費用控除後)	13,507,282円
(B) 有価証券売買等損益 (費用控除後、繰越欠損金補填後)	0
(C) 収益調整金	202,630,561
(D) 分配準備積立金	68,583,858
分配対象収益額(A+B+C+D)	284,721,701
(1万口当たり収益分配対象額)	(3,043)
収益分配金	0
(1万口当たり収益分配金)	(0)

# LM・豪ドル債券マザーファンド

## 運用状況のご報告

第35期 決算日 2020年12月10日

(計算期間：2020年6月11日～2020年12月10日)

－ 受益者のみなさまへ －

法令・諸規則に基づき、「LM・豪ドル債券マザーファンド」の第35期の運用状況をご報告申し上げます。

◇当ファンドの仕組みは、次の通りです。

商 品 分 類	親投資信託
信 託 期 間	無期限
運 用 方 針	<ol style="list-style-type: none"><li>1. ブルームバーグオーストラリア債券（総合）インデックス（為替ヘッジなし、円換算ベース）を参考指標として運用を行います。</li><li>2. 豪ドル建の国債、州政府債、国際機関債、社債、モーゲージ証券及び資産担保証券等を主要投資対象とします。投資を行う公社債は、取得時において、原則として格付機関からA-/A3以上の格付を付与されたものとします。</li><li>3. デュレーション・コントロール、セクター配分、銘柄選定の3つの戦略により超過収益の獲得を目指します。</li><li>4. シナリオ・ディペンデント・オプティマイゼーション（SDO）を活用したデュレーション・コントロールを行います。ポートフォリオの平均デュレーションは、原則として参考指標のデュレーション±1年とします。</li><li>5. 外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。したがって、基準価額は、円と豪ドルとの為替変動の影響を受けます。</li></ol>
主 要 運 用 対 象	主として豪ドル建の国債、州政府債、国際機関債、社債、モーゲージ証券及び資産担保証券等を主要投資対象とします。
組 入 制 限	外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額	騰落率		債組入比率	債券率	債先物比率	純資産額
		期騰	中率				
31期(2018年12月10日)	円 23,726		% 0.3	% 97.3	% 0.5	百万円 86,022	
32期(2019年6月10日)	23,686		△0.2	97.3	△0.3	78,307	
33期(2019年12月10日)	23,858		0.7	97.8	△0.4	70,460	
34期(2020年6月10日)	24,336		2.0	96.7	2.7	65,235	
35期(2020年12月10日)	25,821		6.1	97.9	0.4	60,661	

(注) 債券先物比率は買建比率－売建比率。

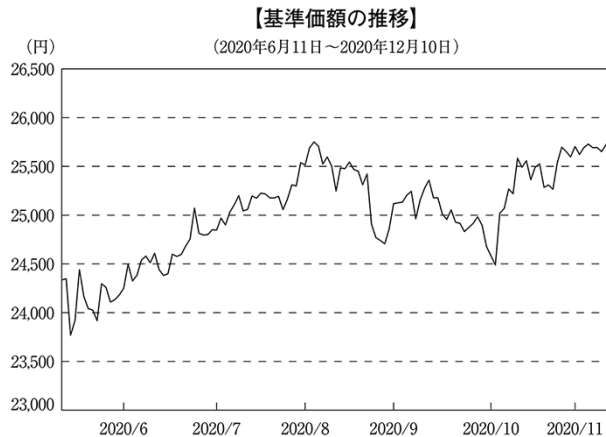
(注) 市場に広く認知されているベンチマーク等で、当ファンドのリスク特性を正確に反映する指標が見当たらないため、現状では、当ファンドの収益率およびリスク特性を特定のベンチマーク等と比較しておりません。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率		債組入比率	債券率	債先物比率
		期騰	率			
(期首) 2020年6月10日	円 24,336		% -	% 96.7	% 2.7	
6月末	24,249		△0.4	98.0	1.1	
7月末	24,847		2.1	97.7	0.2	
8月末	25,513		4.8	97.5	1.3	
9月末	25,118		3.2	98.3	0.2	
10月末	24,583		1.0	98.5	1.3	
11月末	25,704		5.6	98.1	0.9	
(期末) 2020年12月10日	25,821		6.1	97.9	0.4	

(注) 騰落率は期首比です。

(注) 債券先物比率は買建比率－売建比率。



### ○基準価額の主な変動要因

当期の当ファンドのパフォーマンス（騰落率）は、プラスとなりました。

公社債利金を手堅く確保したことに加え、公社債損益がプラスとなりました。為替損益についても、豪ドル・円相場が豪ドル高・円安となったことから、プラスとなりました。

当期のオーストラリア債券市場は、短中期債を中心に利回りが低下（価格は上昇）しました。

期の前半は、米連邦準備制度理事会（FRB）が長期にわたって緩和的な金融政策を継続する方針を示し、米国国債利回りが低下した影響で、オーストラリアの利回りも低下しました。その後も、ビクトリア州メルボルンの一部地域でロックダウン（都市封鎖）が再実施されるなど、新型コロナウイルスの感染拡大第2波への警戒感が意識される中、利回りは低下基調となりました。

期の半ばは、新型コロナウイルスのワクチン開発への期待などを背景に主要国の株式相場が上昇する中、利回りは上昇（価格は下落）しました。しかしその後は、オーストラリア準備銀行（RBA）が追加緩和策として金融機関向けの資金支援策（ターム・ファンディング・ファシリティ）の拡充を公表したことを受けて、利回りは低下しました。

期の後半は、RBAが政策金利の引き下げと国債買い入れ増額を含む追加の金融緩和策を決定したことなどから、利回りは低下しました。しかしその後は、新型コロナウイルスのワクチンが早期に普及し、経済活動の正常化が進むとの見方が広がったことから、利回りは上昇しました。

社債セクターについては、株式相場が上昇したことなどから、社債スプレッド（国債に対する上乘せ利回り）は縮小しました。

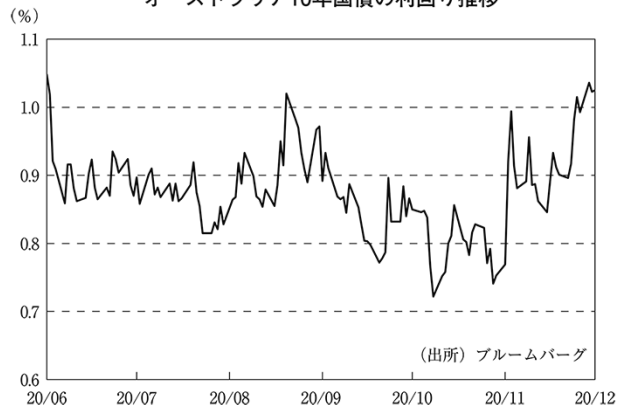
当期の豪ドル・円相場は、豪ドル高・円安となりました。

期の前半は、新型コロナウイルスの感染拡大第2波に対する懸念が浮上する場面などで、豪ドルは対円で上値の重い展開となりましたが、主要国の株式相場や資源価格が概ね回復基調を辿り、投資家のリスク回避姿勢が和らいだことなどから、豪ドルは対円で上昇しました。

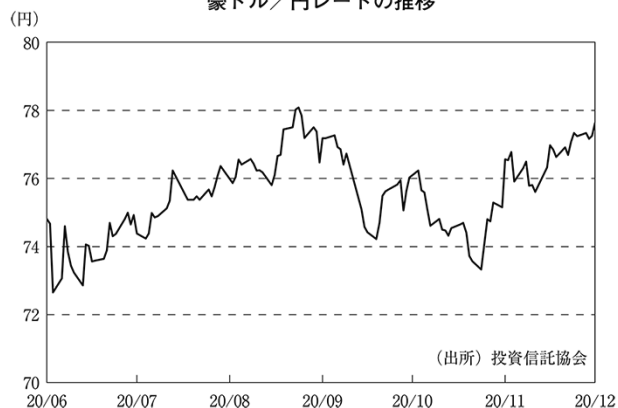
期の半ばは、新型コロナウイルスのワクチン開発への期待感などを背景に主要国の株式相場が上昇する中、リスク回避姿勢の後退が意識されたことから、豪ドル買い・円売りが強まりました。しかしその後は、RBAが追加緩和策として金融機関向けの資金支援策の拡充を公表したことを受けて、豪ドルは対円で下落しました。

期の後半は、RBAによる追加利下げ観測が高まったことや、欧米の新型コロナウイルス感染再拡大を受けてリスク回避姿勢が強まったことなどから、豪ドル売り・円買いが強まりました。しかしその後は、新型コロナウイルスのワクチンの普及による経済活動正常化への期待が高まったことなどから、豪ドル買い・円売りが優勢となりました。

### オーストラリア10年国債の利回り推移



### 豪ドル／円レートの推移



## 当ファンドのポートフォリオ

当ファンドは豪ドル建ての国債、州政府債、国際機関債、社債、モーゲージ証券および資産担保証券等を主要投資対象とし、長期的に安定した利金（インカム）収入が期待できるポートフォリオの運用を行いました。当ファンドは原則としてA-/A3格以上の格付けの公社債へ投資し、信用リスクの抑制を図る等、安定的な運用を目指しております。当期においては、金融債、リート・セクター等を中心とした社債を引き続き厚めとしました。金融債の組み入れにおいては、カバードボンド（債権担保付社債の一種）や、大手金融機関が発行する流動性・信用力が相対的に高い債券が組み入れの中心となっています。また、ポートフォリオ全体の平均格付けは引き続き高位に保ちました。

### ○今後の運用方針

当ファンドは、豪ドル建ての国債、州政府債、国際機関債、社債、モーゲージ証券および資産担保証券等を主要投資対象とするファンドです。引き続き、市場環境に注視しながら、組入債券の信用リスク、金利リスク等に配慮しつつ銘柄を厳選し、運用に注力していく所存です。

## ○1万口当たりの費用明細

(2020年6月11日～2020年12月10日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (先物・オプション)	円 0 (0)	% 0.001 (0.001)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) そ の 他 費 用 ( 保 管 費 用 )	1 (1)	0.004 (0.004)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
合 計	1	0.005	
期中の平均基準価額は、25,002円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

## ○売買及び取引の状況

(2020年6月11日～2020年12月10日)

### 公社債

		買 付 額	売 付 額	
外 国	オーストラリア	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル	
		国債証券	24,991	29,062
		地方債証券	16,422	26,353
		特殊債券	1,777	20,291 ( 28)
	社債券(投資法人債券を含む)	45,752	78,145 (18,880)	

(注) 金額は受渡し代金。(経過利息分は含まれておりません。)

(注) 単位未満は切捨て。

(注) ( ) 内は償還による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注) 社債券(投資法人債券を含む)には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。



## 先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外国	債券先物取引	百万円 8,043	百万円 9,862	百万円 12,085	百万円 12,371

(注) 単位未満は切捨て。

(注) 外国の取引金額は、各月末（決算日の属する月については決算日）の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

## ○利害関係人との取引状況等

(2020年6月11日～2020年12月10日)

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

## ○組入資産の明細

(2020年12月10日現在)

### 外国公社債

#### (A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 未							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
オーストラリア	千オーストラリアドル 681,849	千オーストラリアドル 764,918	千円 59,372,949	% 97.9	% —	% 52.2	% 32.9	% 12.7
合 計	681,849	764,918	59,372,949	97.9	—	52.2	32.9	12.7

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注) 金額の単位未満は切捨て。

## (B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	銘柄	当期末				償還年月日	
		利率	額面金額	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
オーストラリア		%	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル	千円		
	国債証券	AUSTRALIA GOVT INFL	2.2566	1,640	2,558	198,608	2035/8/21
		AUSTRALIAN GOVT	4.75	9,000	11,372	882,760	2027/4/21
		AUSTRALIAN GOVT	2.75	9,200	10,536	817,827	2027/11/21
		AUSTRALIAN GOVT	2.25	18,600	20,701	1,606,830	2028/5/21
		AUSTRALIAN GOVT	3.25	10,750	12,855	997,818	2029/4/21
		AUSTRALIAN GOVT	2.75	3,400	3,938	305,737	2029/11/21
		AUSTRALIAN GOVT	2.5	1,520	1,731	134,422	2030/5/21
		AUSTRALIAN GOVT	1.0	3,000	2,994	232,440	2030/12/21
		AUSTRALIAN GOVT	1.5	5,000	5,219	405,106	2031/6/21
		AUSTRALIAN GOVT	4.5	9,410	13,011	1,009,951	2033/4/21
		AUSTRALIAN GOVT	2.75	13,800	16,265	1,262,518	2035/6/21
		AUSTRALIAN GOVT	3.75	8,900	11,774	913,910	2037/4/21
		AUSTRALIAN GOVT	3.25	7,890	9,863	765,637	2039/6/21
		AUSTRALIAN GOVT	2.75	8,870	10,315	800,699	2041/5/21
		AUSTRALIAN GOVT	3.0	9,430	11,479	891,025	2047/3/21
		AUSTRALIAN GOVT	1.75	9,150	8,561	664,505	2051/6/21
	地方債証券	AUCKLAND COUNCIL	5.843	4,000	4,261	330,760	2022/3/22
		AUCKLAND COUNCIL	2.9	700	763	59,263	2027/9/16
		AUST CAPITAL TERRITORY	1.25	1,000	1,041	80,816	2025/5/22
		AUST CAPITAL TERRITORY	3.0	2,000	2,300	178,529	2028/4/18
		AUST CAPITAL TERRITORY	2.25	1,000	1,094	84,929	2029/5/22
		BRITISH COLUMBIA PROV OF	4.25	6,000	6,864	532,820	2024/11/27
		KUNTARAHOTIUS OYJ	3.5	1,000	1,140	88,523	2026/2/4
		MANITOBA PROVANCE	3.75	500	578	44,917	2026/6/9
		NEW S WALES TREAS CORP	5.0	6,000	7,046	546,936	2024/8/20
		NEW S WALES TREAS CORP	4.0	7,500	8,895	690,499	2026/5/20
		NEW S WALES TREAS CORP	3.0	3,000	3,435	266,627	2027/5/20
		NEW S WALES TREAS CORP	3.0	2,500	2,879	223,477	2028/3/20
		NEW S WALES TREAS CORP	3.0	5,040	5,850	454,094	2030/2/20
		NEW S WALES TREASURY	3.0	7,000	8,123	630,518	2029/4/20
		NEW S WALES TREASURY	2.0	7,900	8,416	653,319	2031/3/20
		NORTHERN TERRITORY TREAS	6.0	2,000	2,362	183,366	2024/3/15
		NORTHERN TERRITORY TREAS	2.75	1,000	1,122	87,116	2027/4/21
		NORTHERN TERRITORY TREAS	3.5	2,000	2,358	183,104	2028/4/21
		NORTHERN TERRITORY TREAS	2.0	1,000	1,065	82,714	2029/5/21
		NORTHERN TERRITORY TREAS	3.75	4,000	4,745	368,310	2033/4/21
		PROVINCE OF QUEBEC	3.7	2,000	2,306	179,007	2026/5/20
		QUEBEC PROVINCE	4.2	3,000	3,450	267,798	2025/3/10
		QUEENSLAND TREASURY	5.75	5,500	6,587	511,293	2024/7/22
		QUEENSLAND TREASURY	4.75	6,400	7,673	595,644	2025/7/21
		QUEENSLAND TREASURY	3.25	12,500	14,372	1,115,574	2026/7/21
		QUEENSLAND TREASURY	2.75	4,000	4,533	351,860	2027/8/20
		QUEENSLAND TREASURY	3.25	7,100	8,346	647,847	2028/7/21
		QUEENSLAND TREASURY	2.5	5,700	6,377	495,030	2029/3/6
		QUEENSLAND TREASURY	3.25	3,100	3,675	285,295	2029/8/21
		QUEENSLAND TREASURY	1.75	2,200	2,292	177,927	2031/8/21
		QUEENSLAND TREASURY	6.5	2,000	3,132	243,163	2033/3/14

銘柄		当期末				償還年月日
		利率	額面金額	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
オーストラリア		%	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル	千円	
	地方債証券					
	SOUTH AUST GOVT FIN	2.25	1,000	1,071	83,189	2024/8/15
	SOUTH AUST GOVT FIN	2.75	2,000	2,201	170,897	2025/4/16
	SOUTH AUST GOVT FIN	3.0	5,500	6,237	484,179	2026/7/20
	SOUTH AUST GOVT FIN	3.0	1,200	1,383	107,356	2028/5/24
	SOUTH AUST GOVT FIN	2.75	500	569	44,221	2030/5/24
	TASMANIAN PUBLIC FINANCE	4.0	5,500	6,211	482,135	2024/6/11
	TASMANIAN PUBLIC FINANCE	3.25	2,000	2,276	176,695	2026/2/19
	TASMANIAN PUBLIC FINANCE	3.25	2,000	2,323	180,348	2028/1/24
	TREASURY CORP VICTORIA	5.5	4,500	5,784	448,987	2026/11/17
	TREASURY CORP VICTORIA	3.0	11,200	12,940	1,004,474	2028/10/20
	TREASURY CORP VICTORIA	2.5	5,500	6,140	476,632	2029/10/22
	TREASURY CORP VICTORIA	4.75	1,600	2,122	164,727	2030/11/20
	TREASURY CORP VICTORIA	1.5	4,900	4,987	387,096	2030/11/20
	TREASURY CORP VICTORIA	4.25	500	649	50,404	2032/12/20
	VICTORIA TREASURY	5.5	6,000	7,233	561,439	2024/12/17
	WESTERN AUST TREAS CORP	2.5	2,000	2,161	167,797	2024/7/23
	WESTERN AUST TREAS CORP	3.0	4,500	5,135	398,644	2026/10/21
	WESTERN AUST TREAS CORP	3.0	3,000	3,459	268,522	2027/10/21
	WESTERN AUST TREAS CORP	3.25	2,820	3,324	258,060	2028/7/20
	WESTERN AUST TREAS CORP	2.75	2,700	3,094	240,159	2029/7/24
	WESTERN AUST TREAS CORP	1.75	600	628	48,762	2031/10/22
	WESTERN AUST TREAS CORP	2.0	900	932	72,386	2034/10/24
	特殊債券 (除く金融債)					
	AFRICAN DEV BANK	4.75	4,000	4,554	353,487	2024/3/6
	ASIAN DEVELOPMENT BANK	3.4	3,000	3,512	272,616	2027/9/10
	ASIAN DEVELOPMENT BANK	3.3	1,500	1,765	137,022	2028/8/8
	CORP ANDINA DE FOMENTO	6.25	5,000	5,594	434,206	2023/11/8
	CORP ANDINA DE FOMENTO	4.5	8,000	8,787	682,081	2025/6/5
	EUROPEAN INVESTMENT BANK	1.7	2,000	2,102	163,169	2024/11/15
	EUROPEAN INVT BK	4.75	1,500	1,739	134,993	2024/8/7
	FMACB 2013-1E A1	1.1168	252	251	19,538	2044/12/10
	INTL FINANCE CORP	3.2	1,500	1,714	133,099	2026/7/22
	KFW	5.0	2,000	2,304	178,907	2024/3/19
	KFW	4.0	3,000	3,447	267,609	2025/2/27
	KFW	3.2	3,500	4,011	311,388	2026/9/11
	KOMMUNINVEST	4.75	2,000	2,141	166,248	2022/8/17
	LANDWIRTSCH. RENTENBANK	4.75	4,000	4,886	379,273	2026/5/6
	LANDWIRTSCH. RENTENBANK	4.25	2,000	2,308	179,156	2025/1/9
	LGFV PROGRAM TRUST	4.31	5,000	5,163	400,767	2021/11/12
	普通社債券 (含む投資法人債券)					
	AIRSERVICES AUSTRALIA	2.2	500	526	40,895	2030/5/15
	AMP WHOLESALE OFFICE FUN	4.75	6,500	6,583	510,993	2021/10/7
	APPLE INC	3.35	1,500	1,633	126,796	2024/1/10
	APPLE INC	3.6	1,000	1,153	89,526	2026/6/10
	AUSNET SERVICES HOLDINGS	4.4	2,000	2,405	186,725	2027/8/16
	AUSNET SERVICES HOLDINGS	4.2	4,500	5,411	420,031	2028/8/21
	AUSNET SERVICES HOLDINGS	2.6	500	536	41,636	2029/7/31
	AUST & NZ BANKING GROUP	3.35	5,000	5,365	416,473	2023/5/9
	AUST & NZ BANKING GROUP	5.0	1,500	1,687	130,970	2023/8/16
	AUST & NZ BANKING GROUP	3.1	2,500	2,712	210,509	2024/2/8

銘	柄	当 期 末				
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
オーストラリア		%	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル	千円	
	普通社債券 (含む投資法人債類)					
	AUST & NZ BANKING GROUP	1.55	2,000	2,079	161,440	2024/8/29
	AUST & NZ BANKING GROUP	1.65	1,500	1,568	121,732	2025/1/16
	AUSTRALIAN CATHOLIC UNI	3.7	1,290	1,442	111,979	2027/8/3
	AUSTRALIAN NATIONAL UNIV	3.98	1,000	1,134	88,097	2025/11/18
	AUSTRALIAN PRIME PROPERT	5.5	5,000	5,234	406,274	2022/11/4
	AUSTRALIAN PRIME PROPERT	3.75	6,000	6,146	477,060	2024/5/22
	BANK OF MONTREAL	3.25	1,500	1,579	122,624	2022/10/6
	BANK OF NOVA SCOTIA	3.2	1,400	1,504	116,750	2023/9/7
	BK NEDERLANDSE GEMEENTEN	5.25	3,500	4,078	316,574	2024/5/20
	BK NEDERLANDSE GEMEENTEN	3.5	2,000	2,332	181,079	2027/7/19
	BK OF COMMUNICATIONS FRN	0.92	1,500	1,506	116,942	2023/9/29
	BK TOKYO-MIT UFJ SYDNEY	3.4	2,000	2,132	165,502	2023/3/20
	BNG BANK NV	3.3	1,500	1,756	136,332	2029/4/26
	BPCE SA	1.8	3,000	3,085	239,522	2024/9/11
	BPCE SA	2.0	2,500	2,610	202,636	2025/6/5
	BWP TRUST	3.5	1,500	1,554	120,628	2022/5/11
	BWP TRUST	3.3	600	662	51,428	2026/4/10
	CANADIAN IMPERIAL BANK	1.6	2,000	2,047	158,934	2023/6/9
	CHARTER HALL EXCH FIN	2.317	1,200	1,218	94,550	2030/9/25
	COCA-COLA CO	3.25	1,000	1,089	84,570	2024/6/11
	COM BK AUSTRALIA	4.75	2,000	2,284	177,358	2024/5/27
	COMMONWEALTH BANK AUST	3.25	2,500	2,675	207,641	2023/4/25
	COMMONWEALTH BANK AUST	3.2	1,500	1,615	125,385	2023/8/16
	COMMONWEALTH BANK AUST	3.0	1,200	1,296	100,639	2024/1/11
	COMMONWEALTH BANK AUST	3.25	3,000	3,417	265,295	2026/11/17
	DEUTSCHE BAHN FIN GMBH	3.8	1,000	1,144	88,858	2027/9/27
	DEXUS FINANCE PTY LTD	4.25	3,200	3,689	286,384	2027/5/11
	DEXUS FINANCE PTY LTD	2.5	1,600	1,645	127,727	2029/10/17
	DEXUS FINANCE PTY LTD	3.0	1,500	1,582	122,862	2032/2/3
	DEXUS WHOLESALE PROPERTY	4.25	5,000	5,170	401,303	2022/6/16
	DEXUS WHOLESALE PROPERTY	4.75	1,000	1,137	88,287	2025/6/16
	ETSA UTILITIES FINAN FRN	1.04	1,000	1,005	78,036	2022/8/29
	ETSA UTILITIES FINANCE	3.5	5,500	6,028	467,936	2024/8/29
	EXPORT-IMPORT BANK KOREA	1.311	900	917	71,244	2023/5/29
	FEDERATION CENTRES LTD	5.0	6,800	6,930	537,971	2021/5/27
	FONTERRA COOPERATIVE GRO	5.5	4,000	4,620	358,635	2024/2/26
	FONTERRA COOPERATIVE GRO	4.0	500	590	45,867	2027/11/2
	GENERAL PROPERTY TRUST	2.849	600	625	48,518	2032/2/20
	GPT RE LTD	3.6725	1,900	2,068	160,572	2024/9/19
	GPT WHL OFFICE FD NO1	4.0	3,000	3,091	239,924	2022/5/18
	GPT WHL OFFICE FD NO1	4.52	1,950	2,284	177,351	2027/2/22
	HSBC BANK AUSTRALIA	5.25	5,000	5,405	419,543	2022/9/7
	HSBC HOLDINGS PLC	3.35	3,000	3,126	242,686	2024/2/16
	ICPF FINANCE PTY LTD	4.25	2,500	2,840	220,487	2027/4/21
	ING BANK (AUSTRALIA) LTD	3.0	1,300	1,390	107,895	2023/9/7
	ING BANK (AUSTRALIA) LTD	1.45	1,000	1,030	79,968	2024/8/20
	INTEL CORP	4.0	1,500	1,607	124,774	2022/12/1
	JOHN DEERE FINANCIAL LTD	1.75	2,500	2,613	202,871	2024/10/4

銘	柄	当 期 末				
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
オーストラリア		%	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル	千円	
	普通社債券 (含む投資法人債類)					
	JP MORGAN CHASE & CO	4.5	3,000	3,481	270,271	2026/1/30
	KOMMUNALBANKEN AS	2.7	570	606	47,068	2023/9/5
	KOREA DEVELOPMENT BANK	1.5	2,000	2,054	159,492	2024/8/29
	KOREA EXPRESSWAY CORP	0.928	1,300	1,309	101,664	2023/9/2
	L-BANK BW FOERDERBANK	2.7	2,800	2,962	229,950	2023/6/19
	LLOYDS BANK PLC	1.65	2,500	2,545	197,560	2022/8/12
	MACQUARIE BANK LTD	1.75	1,000	1,021	79,302	2022/6/21
	MACQUARIE BANK LTD	1.75	1,500	1,562	121,297	2024/8/7
	MACQUARIE UNIVERSITY	3.5	2,000	2,289	177,700	2028/9/7
	MACQUARIE UNIVERSITY	2.25	2,500	2,559	198,660	2030/5/22
	MC FINANCE AUSTRALIA P/L	4.25	2,000	2,068	160,522	2021/12/1
	METLIFE GLOB FUNDING I	4.75	2,000	2,063	160,175	2021/9/17
	METLIFE GLOB FUNDING I	4.0	3,767	4,337	336,665	2027/7/13
	MIZUHO BANK LTD/SYDNEY	1.7	2,600	2,695	209,224	2024/8/7
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	6.0	4,000	4,363	338,659	2022/8/8
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	3.0	1,500	1,587	123,257	2023/2/10
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	3.0	1,000	1,061	82,430	2023/3/16
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	2.9	1,500	1,619	125,737	2024/2/26
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	5.0	1,000	1,147	89,090	2024/3/11
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	2.15	1,200	1,272	98,775	2024/6/19
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	5.0	5,000	5,802	450,362	2024/6/25
	NED WATERSCHAPBK	5.25	2,000	2,319	180,073	2024/4/18
	NEDER FINANCIERINGS-MAAT	4.75	3,500	4,051	314,487	2024/9/11
	NEDER WATERSCHAPSBANK	3.15	1,000	1,133	87,979	2026/9/2
	OPTUS FINANCE PTY LTD	4.0	5,000	5,275	409,519	2022/6/17
	OPTUS FINANCE PTY LTD	3.25	3,000	3,224	250,277	2023/9/6
	OPTUS FINANCE PTY LTD	1.6	1,000	1,035	80,386	2025/7/1
	OPTUS FINANCE PTY LTD	2.5	2,000	2,135	165,773	2030/7/1
	PACCAR FINANCIAL PTY LTD	3.0	1,400	1,462	113,524	2022/9/13
	PACCAR FINANCIAL PTY LTD	2.1	1,800	1,872	145,366	2023/6/13
	PACCAR FINANCIAL PTY LTD	0.9	1,500	1,518	117,879	2024/9/24
	QIC SHOPPING CENTRE FUND	3.75	3,500	3,726	289,247	2023/12/6
	QIC SHOPPING CENTRE FUND	2.0	1,800	1,817	141,051	2025/8/15
	RABOBANK NEDERLAND(AUST)	5.5	5,000	5,804	450,580	2024/4/11
	SCENTRE GROUP TRUST	6.0	5,000	5,335	414,149	2022/7/4
	SCENTRE MGMT LTD	4.5	9,000	9,174	712,111	2021/9/8
	SGSP AUSTRALIA ASSETS	5.5	1,500	1,519	117,962	2021/3/12
	SGSP AUSTRALIA ASSETS	3.75	500	541	42,007	2023/6/28
	SGSP AUSTRALIA ASSETS	3.75	2,600	2,897	224,901	2024/9/27
	SGSP AUSTRALIA ASSETS	1.843	2,700	2,767	214,844	2028/9/15
	SHINHAN BANK	1.183	2,200	2,219	172,280	2025/9/29
	SPARK FINANCE LTD	4.0	2,000	2,355	182,840	2027/10/20
	SPARK FINANCE LTD	2.6	1,600	1,695	131,577	2030/3/18
	STOCKLAND TRUST MGMNT	4.5	9,000	9,528	739,565	2022/11/23
	STOCKLAND TRUST MGMNT	3.3	1,900	2,013	156,255	2024/3/22
	SUMITOMO MITSUI FINL FRN	1.33	2,000	2,027	157,411	2024/10/16
	SUNCORP-METWAY	3.0	2,000	2,143	166,361	2023/9/13
	SUNCORP-METWAY LTD	1.85	1,000	1,041	80,859	2024/7/30

銘	柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
オーストラリア		%	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル	千円	
	普通社債券 (含む数資法人債券)					
	SUNCORP-METWAY LTD	3.25	6,000	6,741	523,269	2026/8/24
	SVENSKA HANDELSBANKEN AB	3.25	2,000	2,152	167,049	2023/9/27
	TELSTRA CORP LTD	4.0	4,700	5,000	388,140	2022/9/16
	TELSTRA CORP LTD	4.0	3,000	3,527	273,808	2027/4/19
	TORONTO-DOMINION BANK	2.05	2,700	2,828	219,528	2024/7/10
	TOYOTA FINANCE AUSTRALIA	1.3	3,000	3,047	236,520	2023/2/17
	TOYOTA FINANCE AUSTRALIA	3.3	2,700	2,902	225,275	2023/11/22
	TRANSPower NEW ZEALAND L	5.75	1,000	1,143	88,732	2023/8/28
	UBS AG AUSTRALIA	3.25	3,000	3,186	247,304	2023/3/8
	UBS AG AUSTRALIA	1.2	900	917	71,202	2025/7/30
	UNI OF TECHNOLOGY/SYDNEY	3.75	830	953	74,023	2027/7/20
	UNITED ENERGY DISTRIBUTI	3.85	2,400	2,674	207,606	2024/10/23
	UNITED ENERGY DISTRIBUTI	2.2	2,000	2,124	164,895	2026/10/29
	UNIVERSITY OF SYDNEY	3.75	2,500	2,804	217,656	2025/8/28
	UNIVERSITY OF WOLLONGONG	3.5	2,000	2,231	173,196	2027/12/8
	UNIVERSITY OF WOLLONGONG	1.746	500	496	38,505	2028/12/15
	VICINITY CENTRES	3.5	3,000	3,180	246,892	2024/4/26
	VICINITY CENTRES	4.0	1,370	1,499	116,388	2027/4/26
	VICTORIA POWER NETWORKS	4.0	2,500	2,902	225,278	2027/8/18
	WESTERN SYDNEY UNI	1.606	700	703	54,586	2027/12/8
	WESTPAC BANKING	3.2	3,000	3,195	248,012	2023/3/6
	WESTPAC BANKING	3.0	3,500	3,801	295,106	2024/4/24
	WESTPAC BANKING	2.25	1,500	1,598	124,070	2024/8/16
	WOORI BANK	0.839	3,000	3,011	233,721	2023/10/23
	ZURICH FIN AUSTRALIA LTD	3.477	3,000	3,197	248,203	2023/5/31
合	計				59,372,949	

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注) 額面・評価額の単位未満は切捨て。

### 先物取引の銘柄別期末残高

銘	柄	別	当 期 末	
			買 建 額	売 建 額
外 国	債券先物取引	オーストラリア国債(10年)2020.12限月	百万円 5,620	百万円 —
		オーストラリア国債(3年)2020.12限月	—	5,384

(注) 単位未満は切捨て。

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

## ○投資信託財産の構成

(2020年12月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 59,372,949	% 97.5
コール・ローン等、その他	1,498,225	2.5
投資信託財産総額	60,871,174	100.0

(注) 金額の単位未満は切捨て。

(注) 当期末における外貨建純資産 (60,478,791千円) の投資信託財産総額 (60,871,174千円) に対する比率は99.4%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売相場場の仲値により邦貨換算したものです。なお、12月10日における邦貨換算レートは1オーストラリアドル=77.62円です。

## ○特定資産の価格等の調査

(2020年6月11日～2020年12月10日)

該当事項はございません。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年12月10日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	61,139,437,491
コール・ローン等	626,438,506
公社債(評価額)	59,372,949,105
未収入金	561,046,230
未収利息	405,028,669
前払費用	10,301,276
差入委託証拠金	163,673,705
(B) 負債	477,498,703
未払金	358,471,781
未払解約金	119,026,156
未払利息	766
(C) 純資産総額(A-B)	60,661,938,788
元本	23,493,216,260
次期繰越損益金	37,168,722,528
(D) 受益権総口数	23,493,216,260口
1万口当たり基準価額(C/D)	25,821円

<注記事項>

元本の状況

期首元本額 26,805,735,846円

期中追加設定元本額 311,853,740円

期中一部解約元本額 3,624,373,326円

期末における元本の内訳

LM・オーストラリア毎月分配型ファンド  
22,287,500,349円

LM・オーストラリア毎月分配型ファンド(適格機関投資家専用)  
728,169,659円

LM・オーストラリア債券ファンド(年2回決算型)  
397,490,247円

LM・オーストラリア・インカム・アロケーション・ファンド(毎月分配型)  
40,517,066円

LM・オーストラリア・インカム・アロケーション・ファンド(年2回決算型)  
39,538,939円

○損益の状況 (2020年6月11日～2020年12月10日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,013,549,563
受取利息	1,013,117,808
その他収益金	528,486
支払利息	△ 96,731
(B) 有価証券売買損益	2,693,736,406
売買益	2,928,047,590
売買損	△ 234,311,184
(C) 先物取引等取引損益	31,652,700
取引益	94,963,224
取引損	△ 63,310,524
(D) 保管費用等	△ 2,717,837
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	3,736,220,832
(F) 前期繰越損益金	38,429,294,960
(G) 追加信託差損益金	464,611,600
(H) 解約差損益金	△ 5,461,404,864
(I) 計(E+F+G+H)	37,168,722,528
次期繰越損益金(I)	37,168,722,528

(注) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注) 損益の状況の中で(G)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) 損益の状況の中で(H)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。